

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Шамсутдинов Рамиль Асгатович

Должность: Директор ЛФ КНИТУ-КАИ

Дата подписания: 12.09.2022 11:00:25

Уникальный программный ключ:

d31c25eab5d6fbb0cc50e03ac64d4dc00729e985e7a997ad1080663082c861114

**Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования «Казанский национальный исследовательский
технический университет им. А.Н. Туполева-КАИ»**

**Лениногорский филиал
Кафедра Экономики и менеджмента**



УТВЕРЖДАЮ

Директор ЛФ КНИТУ-КАИ

Р.А. Шамсутдинов

09

2017г.

Входящий регистрационный номер 0428.09/14-94

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины (модуля)

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Индекс по учебному плану: **Б1.В.ДВ.06.01**

Направление подготовки: **38.03.02 Менеджмент**

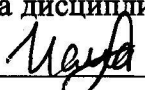
Квалификация: **бакалавр**

Направленность (профиль) программы: **Производственный менеджмент**

Виды профессиональной деятельности: **организационно-управленческая**

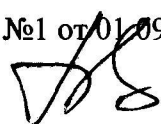
Лениногорск 2017 г.

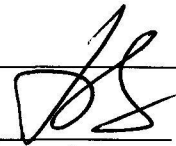
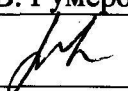
Рабочая программа составлена на основе требований Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 января 2016 г. №7 и в соответствии с рабочим учебным планом направления 38.03.02, утвержденным Ученым советом КНИТУ-КАИ «31» августа 2017г., протокол №6.

Рабочая программа дисциплины (модуля) разработана доцентом кафедры ЭиМ, к.э.н. Исмагиловым Р.Х. 

(подпись преподавателя)

утверждена на заседании кафедры ЭиМ протокол №1 от 01.09.2017г.

Заведующий кафедрой проф, д.э.н. Гумеров А.В. 

Рабочая программа дисциплины:	Наименование подразделения	Дата	№ протокола	подпись
СОГЛАСОВАНА	на заседании кафедры ЭиМ	01.09.2017	№1	 Зав.кафедрой А.В. Гумеров
ОДОБРЕНА	Учебно-методическая комиссия ЛФ КНИТУ-КАИ	01.09.2017	№2	 Председатель УМК З.И.Аскарова
СОГЛАСОВАНА	Научно-техническая библиотека	01.09.2017		 Библиотекарь А.Г. Страшнова

РАЗДЕЛ 1. ИСХОДНЫЕ ДАННЫЕ И КОНЕЧНЫЙ РЕЗУЛЬТАТ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цели изучения дисциплины (модуля)

Целью изучения дисциплины является выработка у студентов знание основных принципов анализа, оценки и учета рисков фирмы в управлении предприятием.

1.2. Задачи дисциплины (модуля)

Основными задачами дисциплины являются:

- дать системное представление о роли и значении рисков в деятельности, показать их природу, субъекты и объекты влияния;
- показать факторы и причины возникновения рисков в деятельности промышленных предприятий, а также их возможные последствия для результатов хозяйственной деятельности;
- научить использовать методы анализа, оценки и учета рисков в деятельности фирмы; комплексного анализа и оценки, эффективного управления рисками организации.
- раскрыть методологическую базу управления рисками, а также принципы и методы снижения рисков в зависимости от их специфики.

1.3. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП ВО

Дисциплина «Управление рисками» входит в состав вариативной части Блока 1 Дисциплины (модули) по выбору.

Логическая и содержательная связь дисциплин, участвующих в формировании представленных в п. 1.5 компетенций:

Компетенция: ПК-7

Предшествующие дисциплины: Инновационный менеджмент; Управление производственными ресурсами.

Дисциплины, изучаемые одновременно: Бизнес-планирование; Управление рисками; Антикризисное управление; Преддипломная практика.

Последующие дисциплины: Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты.

Компетенция: ПК-8

Предшествующие дисциплины: Управление производственными ресурсами; Инновационный менеджмент; Управление предприятием; Планирование на предприятии; Производственное планирование; Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности.

Дисциплины, изучаемые одновременно: Антикризисное управление; Преддипломная практика.

Последующие дисциплины: Управление рисками; Антикризисное управление; Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты.

1.4. Объем дисциплины (модуля) (с указанием трудоемкости всех видов работы)

Таблица 1а

Объем дисциплины (модуля) для очной формы обучения

Виды учебной работы	Общая трудоемкость		Семестр	
			8	
	В ЗЕ	В часах	В ЗЕ	В часах
ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ	5	180	5	180
<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем (аудиторные занятия)</i>	2	72	2	72
Лекции	1	36	1	36

Лабораторные работы	Не предусмотрены			
Практические занятия	1	36	1	36
<i>Самостоятельная работа обучающегося</i>	2	72	2	72
Проработка учебного материала	2	72	2	72
Курсовой проект	Не предусмотрен			
Курсовая работа	Не предусмотрена			
<i>Подготовка к промежуточной аттестации</i>	1	36	1	36
Промежуточная аттестация			Экзамен	

Таблица 16

Объем дисциплины (модуля) для заочной формы обучения

Виды учебной работы	Общая трудоемкость		Семестр	
			9	
	В ЗЕ	В часах	В ЗЕ	В часах
ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ	5	180	5	180
<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем (аудиторные занятия)</i>	0,67	24	0,67	24
Лекции	0,33	12	0,33	12
Лабораторные работы	Не предусмотрены			
Практические занятия	0,33	12	0,33	12
<i>Самостоятельная работа обучающихся</i>	4,08	147	4,08	147
Проработка учебного материала	4,08	147	4,08	147
Курсовой проект	Не предусмотрен			
Курсовая работа	Не предусмотрена			
<i>Подготовка к промежуточной аттестации</i>	0,25	9	0,25	9
Промежуточная аттестация			Экзамен	

1.5 Планируемые результаты обучения

Таблица 2

Формируемые компетенции

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)	Уровни освоения составляющих компетенций		
	Пороговый	Продвинутый	Превосходный
ПК – 7 владением навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов/ умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ			
Знание (ПК-7З) этапов, форм и видов контроля	Знание базовых форм контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений	Знание новых форм и методов контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений	Знание новых форм и методов контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, их взаимосвязь с типом исполнителей
Умение (ПК-7У) вести поиск методов контроля	Умение вести поиск базовых форм контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений	Умение вести поиск новых форм и методов контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений	Умение вести поиск новых форм и методов контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, их взаимосвязь с типом исполнителей
Владение (ПК-7В) методами контроля	Владеть навыками применения базовых форм контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений	Владеть навыками применения новых форм и методов контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений	Владеть навыками применения новых форм и методов контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, их взаимосвязь с типом исполнителей
ПК-8 владением навыками документального оформления решений в управлении операционной (производственной) деятельности организаций при внедрении технологических, продуктовых инноваций или организационных изменений			
Знание (ПК-8З) форм документального оформления решения	Знание форм документального оформления решений при внедрении технологических инноваций	Знание форм документального оформления решений при внедрении продуктовых инноваций	Знание форм документального оформления решений при внедрении организационных изменений
Умение (ПК-8У) вести поиск форм документального оформления решения	Умение вести поиск форм документального оформления решений при внедрении технологических инноваций	Умение вести поиск форм документального оформления решений при внедрении продуктовых инноваций	Умение вести поиск форм документального оформления решений при внедрении организационных изменений
Владение (ПК-8В) методами документального оформления решений	Владение методами документального оформления решений при внедрении технологических инноваций	Владение методами документального оформления решений при внедрении продуктовых инноваций	Владение методами документального оформления решений при внедрении организационных изменений

РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) И ТЕХНОЛОГИЯ ЕЕ ОСВОЕНИЯ

2.1. Структура дисциплины (модуля) и ее трудоемкость

Таблица 3а

Распределение фонда времени по видам занятий (очная форма обучения)

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Коды компетенции	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам.раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	24	6		6	12	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков							ФОС ТК-2
Тема 2.1. Методы оценки рисков	24	6		6	12	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 2.2. Методы анализа рисков	24	6		6	12	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками							ФОС ТК-3
Тема 3.1. Методы управления операционными рисками	24	6		6	12	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.2. Методы управления стратегическими рисками	24	6		6	12	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.3. Система управления рисками	24	6		6	12	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Экзамен	36					ПК-7, ПК-8	ФОС ПА
ИТОГО:	180	36		36	72		

Таблица 3б

Распределение фонда времени по видам занятий (заочная форма обучения)

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Коды компетенции	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам.раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	28	2		2	24	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль

Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков							<i>ФОС ТК-2</i>
Тема 2.1. Методы оценки рисков	30	2		2	26	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 2.2. Методы анализа рисков	30	2		2	26	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками							<i>ФОС ТК-3</i>
Тема 3.1. Методы управления операционными рисками	28	2		2	24	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.2. Методы управления стратегическими рисками	30	2		2	26	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.3. Система управления рисками	25	2		2	21	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Экзамен	9					ПК-7, ПК-8	ФОС ПА
ИТОГО:	180	12		12	147		

Таблица 4

Матрица компетенций по разделам РП

Наименование раздела (тема)	Формируемые компетенции (составляющие компетенций)		
	ПК-7		
	ПК-7З	ПК-7У	ПК-7В
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками			
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	+	+	+
Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков			
Тема 2.1. Методы оценки рисков	+	+	+
Тема 2.2. Методы анализа рисков	+	+	+
Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками			
Тема 3.1. Методы управления операционными рисками	+	+	+
Тема 3.2. Методы управления стратегическими рисками	+	+	+
Тема 3.3. Система управления рисками	+	+	+
	ПК-8		
	ПК-8З	ПК-8У	ПК-8В
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками			
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	+	+	+
Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков			
Тема 2.1. Методы оценки рисков	+	+	+
Тема 2.2. Методы анализа рисков	+	+	+
Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками			
Тема 3.1. Методы управления операционными рисками	+	+	+

Тема 3.2. Методы управления стратегическими рисками	+	+	+
Тема 3.3. Система управления рисками	+	+	+

2.2. Содержание дисциплины (модуля)

Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками

Тема 1.1 Предмет и содержание курса

Предмет управления рисками. Понятие риска и риск-менеджмента. Место курса в системе наук управления. Природа риска. Развитие взглядов на риски. Вклад Блеза Паскаля, Даниила и Якоба Бернулли, Джозефа фон Неймана, Гарри Марковица. Аспекты риска.

Основные виды рисков. Стратегические, операционные (функциональные), финансовые риски и риски опасностей. Кредитный риск. Валютный риск. Процентный риск. Риск колебания рынков. Риск контрагента. Анализ кредитоспособности заемщика. Риск ликвидности. Производные финансовые инструменты: форвардные, фьючерсные и опционные контракты, свопы. Основные спекулятивные и хеджирующие стратегии применения этих инструментов. Риск выбора банка. Экологические и природные риски. Огневые риски. Техногенные риски. Криминальные риски и риск преступлений. Судебные, бухгалтерские и налоговые риски. Риски применения ошибочных схем налоговой оптимизации.

Литература: [1, 2, 3]

Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков

Тема 2.1. Методы оценки рисков

Базовые понятия теории вероятностей и математической статистики в области рисков, финансовой математики, включая стоимость денег во времени, доходность и волатильность, методы ценообразования, эволюции процентных ставок, основные виды вероятностных распределений, элементы регрессионного анализа и метод Монте-Карло.

Стратегия: внешние и внутренние риски компании. Стратегические риски компании. Риски среды. Этапы жизни и динамика рисков компании. Новые, псевдоновые и специфические риски. Мониторинг рисков.

Литература: [1, 2, 3]

Тема 2.2. Методы анализа рисков

Многомерное управление компанией. Многомерность рискового пространства. Развитие компании и управление рисками. Функция управления риском.

Диагностика, анализ и картографирование рисков

Формат идентификации рисков компании. Рисковые спектр и профиль. Методы диагностики рисков компании. Картографирование рисков фирмы.

Литература: [1, 2, 3]

Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками

Тема 3.1 Методы управления операционными рисками

Классификация операционных рисков финансовых и промышленных компаний. Технологические риски. Риски профессиональной ответственности. Риски информационных технологий и систем. Риски ошибок и халатности.

Риски бесперебойной работы. Портфельный подход в управлении рисками.

Развитие взглядов на управление риском. Способы управления рисками. Страхование, резервирование, хеджирование, распределение, диверсификация, минимизация, избегание. Инструменты манипулирования рисками. Передача риска третьей стороне, самостоятельное

удержание риска. Издержки и доходы управления риском. Подверженность риску. Чистый ущерб, вследствие проявления риска. Декомпозиция и агрегирование риска.

Литература: [1, 2, 3]

Тема 3.2 Методы управления стратегическими рисками

Макроэкономические и политические риски, риски непрерывности деятельности, риски ошибок корпоративного управления. Риски, связанные с человеческим фактором.

Юридические риски. Риски изменения законодательства и системы налогообложения. Методы интеграции. Совокупное покрытие рисков. Альянсы и неопределенности. Снижение подверженности рискам. Риски отношений в альянсах. Риски усиления конкуренции в условиях спада: продукция и услуги, коммуникации, сбыт, ценообразование, кадры.

Литература: [1, 2, 3]

Тема 3.3 Система управления рисками

Основные понятия теории стоимости управления. Риски конфликтов. Риски потери качества капитала и ресурса влияния. Риски снижения рентабельности управления. Риски нелояльности и оппортунизма. Риски хищения клиентского портфеля. Риски потери инициативы и интереса к работе. Риски саботажа. Риски некомпетентности и непрофессионализма. Риски работы на сторону. Концепция и опыт интеграции риск-менеджмента. Программа управления рисками: диагностика рисков, комплексный анализ рисков и их количественная оценка, организационная и финансовая стратегия управления рисками. Получение конкурентных преимуществ, рост и развитие, операционная эффективность.

Разработка ситуационных планов. Диверсификация и портфельная теория. Организационная структура службы управления рисками. Мониторинг программы и симптомы раннего оповещения.

Психологические аспекты управления рисками. Поведение людей и управление рисками. Особенности психологической реакции на риск. Правила обращения с рисками.

Литература: [1, 2, 3]

2.3. Курсовой проект/курсовая работа

Курсовая работа по дисциплине Управление рисками в соответствии с учебным планом не предусмотрена.

РАЗДЕЛ 3. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И КРИТЕРИИ ОЦЕНОК ОСВОЕНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

3.1. Оценочные средства для текущего контроля

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля (ФОС ТК) является составной частью РП дисциплины (модуля) и хранится на кафедре.

Фонд оценочных средств текущего контроля

№ п/п	Наименование раздела (модуля)	Вид оценочных средств	Примечание
1	2	3	4
1.	Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками	ФОС ТК-1	Тест текущего контроля дисциплины по первому модулю. Выполнение практических заданий
2.	Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков	ФОС ТК-2	Тест текущего контроля дисциплины по второму модулю. Выполнение практических заданий
3	Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками	ФОС ТК-3	Тест текущего контроля дисциплины по третьему модулю. Выполнение практических заданий

Тестовые материалы для контроля знаний (по разделам)

Типовые оценочные средства для текущего контроля:

1. Что вы понимаете под термином риск?

а) опасность возникновения финансовых преград, в результате которых возможно несение ущерба предприятием;

б) деятельность, связанная с преодолением неопределенности в ситуации неизбежного выбора, в процессе которой имеется возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи и отклонения от цели;

в) возникновение неопределенности в результате внешнего воздействия на проект при неверных управленческих решениях.

2. Работая в условиях полной неопределенности на каких критериях основывается принятие решений?

а) критерий оптимиста, критерий пессимиста;

б) критерий гарантированного результата, критерий обобщенного максимина; критерий минимаксного риска;

в) критерий минимального риска, критерий ликвидации опасности, критерий положительного исхода;

г) все выше перечисленное.

3. В чем заключается сущность критерия Вальда?

а) у объекта минимальный процент благоприятного исхода из сложившейся рискованной ситуации;

б) субъект решения располагает множеством вариантов решения проблемы;

в) субъект должен располагать значительным финансовым потенциалом для решения сложившейся проблемы управления риском;

г) субъект заведомо приговорен к банкротству, если критерий Вальда конкретного предприятия меньше 1.

4. При использовании критерия Сэвиджа на основе чего принимается решение?

а) решение принимается на основе матрицы эффективности;

б) решение принимается на основе ранее рассчитанных критериев оптимиста и пессимиста;

в) решение принимается на основе матрицы рисков.

5. В чем заключается задача проведения качественного анализа рисков?

а) оценка условий возникновения рисков;

б) определение воздействия рисков на проект;

- в) выявление рисков;
- г) все выше перечисленное.

Вопросы по самостоятельной работе

- 1 Классификация рисков.
- 2 Неформализуемые методы управления риском.
- 3 Методы оценки риска.
- 4 Имитационное моделирование.
- 5 Диверсификация как метод управления рисками.
- 6 Особенности хеджирования и страхования рисков.
- 7 Принципы построения дерева решений.
- 8 Диссипация рисков.
- 9 Методы управления рисками.
- 10 Качественный и количественный анализ рисков.
- 11 Экспертный метод оценки рисков.
- 12 Алгоритм принятия решений в условиях риска.
- 13 Страхование рисков.
- 14 Алгоритм принятия решений в условиях полной неопределенности.
- 15 Методы поглощения рисков.
- 16 Методы уклонения от рисков.
- 17 Методы компенсации рисков.

3.2. Оценочные средства для промежуточного контроля

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации (ФОС ПА) является составной частью РП дисциплины, разработан в виде отдельного документа, в соответствии с положением о ФОС ПА.

1. В чем заключается задача проведения количественного анализа рисков?
 - а) возможно осуществление численного измерения влияния факторов риска на проект;
 - б) определение последствий воздействия на проект;
 - в) возможно избежать риск при осуществлении данного вида анализа;
 - г) происходит диверсификация риска.
2. В чем заключается суть метода дерева решений?
 - а) в том, что происходит построение цепочки решений, вытекающих одно из другого;
 - б) необходимо применение сложных математических вычислений;
 - в) нельзя, чтобы результатом было только одно решение, их должно быть минимум три;
 - г) нет необходимости использовать калькулятор.
3. Планирование управления рисками - это процесс ...?
 - а) принятия решений по применению и планированию управления рисками для конкретного проекта;
 - б) принятия решений при горизонтальном управлении направленное на уклонение от рисков;
 - в) распределения рисков учитывающий фактор времени.
4. Что является результатом контроля рисков?
 - а) применение мероприятий согласно стратегии компании направленных на минимизацию возможных рисков проекта;
 - б) аккумулирование информации, необходимой для реализации альтернативных стратегий, принятие корректив, а также внесение изменений в проект для достижения поставленных целей;
 - в) получение постоянного дохода в результате успешной реализации проекта.
5. Какие методы управления рисками вам известны?
 - а) уклонение;
 - б) локализация, компенсация;
 - в) диссипация;
 - г) диверсификация, эмансипация.

Второй этап: вопросы к комплексному заданию

Теоретические навыки:

- 1 Факторы риска и виды риска.
- 2 Неформализуемые методы управления риском.
- 3 Классификация методов оценки риска.
- 4 Виды платы за применение определенного метода снижения риска.
- 5 Методы оценки риска.
- 6 Цели и задачи информационных технологий в управлении риском.
- 7 Имитационное моделирование.
- 8 Диверсификация как метод управления рисками.
- 9 Особенности хеджирования и страхования рисков.
- 10 Принципы построения дерева решений.
- 11 Диссипация рисков.
- 12 Классификация методов управления рисками.
- 13 Качественный и количественный анализ рисков.
- 14 Опцион как метод управления рисками.
- 15 Экспертный метод оценки рисков.
- 16 Алгоритм принятия решений в условиях риска.

Практические навыки: решение задачи из билета

1. Определить, в какой инвестиционный проект (с позиции рискованности) выгоднее вложить денежные средства: в проект А или в проект Б? Построить кривую риска по проекту А и Б. Определить среднее ожидаемое значение прибыли от вложения в проекты А и Б; дисперсию по проектам А и Б; среднее квадратическое отклонение по проектам А и Б; коэффициент вариации по проекту А и по проекту Б.

Возможные значения конъюнктуры инвестиционного рынка	Инвестиционный проект А		Инвестиционный проект Б	
	Расчетный доход, тыс.р., х	Значение вероятности, Р	Расчетный доход, тыс.р., х	Значение вероятности, Р
Высокая	600	0,25	800	0,2
Средняя	500	0,5	450	0,6
Низкая	200	0,05	100	0,2
В целом	-	1	-	1

2. При вложении капитала в мероприятие А из 120 случаев прибыль в 25 тыс. р. может быть получена в 48 случаях; 20 тыс. р. в 36 случаях; 30 тыс. р. в 36 случаях. При вложении капитала в мероприятие Б из 100 случаев прибыль в 40 тыс. р. может быть получена в 30 случаях; 30 тыс. р. в 50 случаях; 15 тыс. р. в 20 случаях. Определить среднее ожидаемое значение прибыли от вложения в мероприятие А и в мероприятие Б; дисперсию по мероприятию А и по мероприятию Б; среднее квадратическое отклонение по мероприятию А и по мероприятию Б; коэффициент вариации по мероприятию А и по мероприятию Б. Определить, в какое мероприятие выгоднее вкладывать денежные средства: в мероприятие А или в мероприятие Б?

3.3. Форма и организация промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

По итогам освоения дисциплины предусмотрено проведение экзамена в два этапа: **тестирование** и **письменный ответ на 2 вопроса и решение задачи.**

Первый этап проводится в виде тестирования в системе **Blackboard**.

Тестирование ставит целью оценить пороговый уровень освоения обучающимися заданных результатов, а также знаний и умений, предусмотренных компетенциями.

Для оценки превосходного и продвинутого уровня усвоения компетенций проводится **второй этап** в виде письменного ответа на 2 вопроса и решение задачи.

3.4. Критерии оценки промежуточной аттестации

Таблица 5

Система оценки промежуточной аттестации

Описание оценки в требованиях к уровню и объему компетенций	Выражение в баллах	Словесное выражение
Освоен превосходный уровень усвоения компетенций	от 86 до 100	Отлично
Освоен продвинутый уровень усвоения компетенций	от 71 до 85	Хорошо
Освоен пороговый уровень усвоения компетенций	от 51 до 70	Удовлетворительно
Не освоен пороговый уровень усвоения компетенций	до 51	Неудовлетворительно

РАЗДЕЛ 4. ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

4.1. Учебно-методическое обеспечение дисциплины

4.1.1. Основная литература:

1. Дараган А.В., Самышева Е.Ю. Статистические методы управления рисками предприятия: учебное пособие. – Казань: Изд-во Казан. гос. техн. ун-та, 2014. -150 с.- Режим доступа: <http://e-library.kai.ru/reader/hu/flipping/Resource-2449/522.pdf/index.html>
2. Управление рисками предприятия. [Электронный ресурс]: учебное пособие / Уродовских В.Н. - М.:Вузовский учебник, ИНФРА-М Издательский Дом, 2017. - 168 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=615086>
3. Управление рисками организации. [Электронный ресурс]: учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. - (Высшее образование: Бакалавриат – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=475625>

4.1.2. Дополнительная литература:

4. Тэпман Л.Н. Риски в экономике: учебное пособие. - М: ЮНИТИ-И-ДАНА, 2004.- 380 с. - рек. УМЦ
5. Управление рисками в инновационной деятельности. [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Грачева М.В., Ляпина С.Ю. - М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 351 с- Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=883754>
6. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 6-е изд. - М.: Дашков и К, 2014. - 880 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=450763>

4.1.3. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

7. Евдокимов АА Введение в теорию риска: учебно-методическое пособие.- СПб: Санкт-Петербургский национальный исследовательский университет информационных технологий, механики и оптики, 2015. 39 с.- URL: <https://e.lanbook.com/reader/book/91505/#1>
8. Богомолов В.А. Антикризисное управление экономики. Теория и практика: учебное пособие. - М: ЮНИТИ-ДАНА, 2003. - 371 с. - рек. УМО
9. Управление рисками. [Электронный ресурс в системе Blackboard] https://bb.kai.ru:8443/webapps/blackboard/content/listContentEditable.jsp?content_id= 246477_1&course_id= 9313_1&mode=reset

4.1.4. Методические рекомендации для студентов, в том числе по выполнению самостоятельной работы

Успешное освоение материала студентами обеспечивается посещением лекций практических занятий, написанием конспекта по темам самостоятельной работы. При подготовке к практическим занятиям, к ТК и ПА студенты должны обращаться к лекционному материалу, указанной литературе и к информационным материалам **в системе Blackboard.**

4.1.5. Методические рекомендации для преподавателей

Цели обучения культурологии могут быть достигнуты путем гармоничного сочетания лекций, различных форм контроля усвоения знаний и самостоятельной работы студентов.

Лекции должны быть содержательными, интересными для слушателей, их содержание не должно повторять содержание учебников. В ходе изложения лекционного материала преподавателю очень важно уметь активизировать работу студентов (особенно в моменты, когда наступают кризисы внимания), задавая актуальные вопросы или приводя интересные примеры и т.д. Также преподаватель должен обучать студентов навыкам конспектирования лекций. Все лекции сопровождают мультимедийные презентации, на которых представлены схемы, таблицы, определения терминов, другой иллюстративный

материал. Это позволяет проиллюстрировать материал, сэкономить время, быстро вернуться к любому из уже рассмотренных вопросов или вовсе изменить последовательность изложения.

После изучения каждого из двух разделов каждый студент должен пройти компьютерное тестирование. Набранные баллы в совокупности с результатами письменных работ и устными ответами на практических занятиях демонстрируют уровень знаний студентов, их умение применять пройденный материал в практических целях.

Экзамен принимается по билетам, включающим два теоретических вопроса, приведенных в программе.

4.2. Информационное обеспечение дисциплины (модуля)

4.2.1 Основное информационное обеспечение

- e-library.kai.ru – Библиотека Казанского национального исследовательского технического университета им. А.Н. Туполева
- elibrary.ru – Научная электронная библиотека
- e.lanbook.ru - ЭБС «Издательство «Лань»
- ibook.ru - Электронно-библиотечная система Айбукс
- <http://znaniyum.com> - Электронно-библиотечная система Знаниум

4.2.2 Дополнительное справочное обеспечение

<http://www.risk-manage.ru/> - статьи по управлению рисками, аналитические материалы;

<http://www.risk24.ru/> - электронный учебник по управлению рисками, статьи;

<http://www.riskmanagement.ru/index.html> - журнал «Риск-менеджмент», архив номеров;

<http://www.hedging.ru/> - сайт практикующих риск-менеджеров, проблемы хеджирования, статьи;

<http://www.finrisk.ru/> - основы управления финансовыми рисками: теория и практика, словарь, тесты, статьи.

4.2.3 Перечень информационных технологий, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

- Microsoft® Windows Professional 7 Russian,
- Microsoft® Office Professional Plus 2010 Russian,
- антивирусная программа Kaspersky Endpoint Security 8
- Ваш финансовый аналитик 2: Сетевой.

4.3 Кадровое обеспечение

4.3.1 Базовое образование

Высшее образование в области управления рисками и /или наличие ученой степени и/или ученого звания в указанной области и /или наличие дополнительного профессионального образования – профессиональной переподготовки в области управления рисками.

4.3.2 Профессионально-предметная квалификация преподавателей

Профессионально-предметная деятельность преподавателей связана с управлением рисками. Направления научных и прикладных работ имеют непосредственное отношение к содержанию и требованиям дисциплины.

Преподаватель участвует в научно-исследовательской работе кафедры, в семинарах и конференциях по направлению исследований кафедры в рамках своей дисциплины. Руководит научно-исследовательской работой студентов, систематически выступает на региональных и международных научных конференциях, публикует научные работы.

4.3.3 Педагогическая (учебно-методическая) квалификация преподавателей

К ведению дисциплины допускаются кадры, имеющие стаж научно-педагогической работы (не менее 1года); практический опыт работы в области управления рисками на должностях руководителей или ведущих специалистов более 3 последних лет.

Обязательное прохождение повышения квалификации (стажировки) не реже чем один раз в три года соответствующее области управления рисками, либо в области педагогики.

4.4. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Для реализации учебного процесса по дисциплине Управление рисками требуется следующее материально-техническое обеспечение:

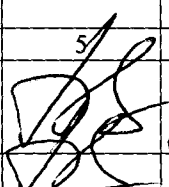
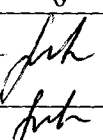
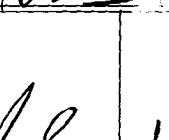
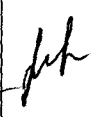
Таблица 6

Материально-техническое обеспечение дисциплины

Наименование раздела (темы) дисциплины	Наименование учебной лаборатории, аудитории, класса	Перечень лабораторного оборудования, специализированной мебели и технических средств обучения	Количество единиц
Раздел 1-3	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа (К. 206)	- мультимедийный проектор; - ноутбук; - настенный экран ; - акустические колонки ; - учебные столы, стулья; - доска; - стол преподавателя ; - учебно – наглядные пособия.	1 1 1 1 28;28 1 1
	Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации (К. 209)	- учебные столы, стулья; - доска; - стол преподавателя ; - учебно – наглядные пособия.	24;24 1 1
	Компьютерная аудитория (Л. 214)	- учебные столы, стулья; - доска; - стол преподавателя; - компьютерные столы, стулья ; - персональные компьютеры; - локальная вычислительная сеть; - ЖК мониторы 23” ; - проекционный экран; - мультимедиа-проектор.	15;15 1 1 15;15 15 1 15 1 1
	Помещение для самостоятельной работы студента (Л. 112)	- персональный компьютер; - ЖК монитор 19”; - столы компьютерные; - учебные столы, стулья .	9 9 9 8;25

РАЗДЕЛ 5. ВНОСИМЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ И УТВЕРЖДЕНИЯ

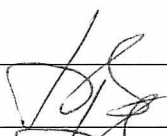
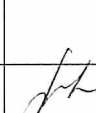
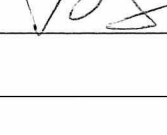
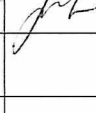
5.1. Лист регистрации изменений, вносимых в рабочую программу дисциплины (модуля)

№ п/п	№ раздела внесения изменений	Дата внесения изменений	Содержание изменений	«Согласовано» Зав. кафедрой Э и М	«Согласовано» председатель УМК филиала
1	2	3	4	5	6
1	4.2.3	26.02.2018	Дополнение в Пункт 4.2.3: Альт-Инвест Сумм 7 Альт-Финансы 2		
2	4.2.1	01.10.2018	Дополнение в Пункт 4.2.1. Актуализация - Бюджетно-финансовое обеспечение. Юридический отдел РГПУ им. А.Н. Туполева-КАИ		
3	Титульный лист	31.01.2019	Изменение наименования учредителя университета. В соответствии с утверждением устава федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Казанский национальный исследовательский технический университет им. А.Н. Туполева-КАИ» в новой редакции (Приказ № 1042 от 26.11.2018) наименование «Министерство образования и науки Российской Федерации» читать как «Министерство науки и высшего образования Российской Федерации»		

РАЗДЕЛ 5. ВНОСИМЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ И УТВЕРЖДЕНИЯ

5.1. Лист регистрации изменений, вносимых в рабочую программу дисциплины (модуля)

(продолжение)

№ п/п	№ раздела внесения изменений	Дата внесения изменений	Содержание изменений	«Согласовано» Зав. каф. ЭиМ	«Согласовано» председатель УМК филиала
1	2	3	4	5	6
4	Стр.2	01.07.2019	Первый абзац читать в следующей редакции «Рабочая программа составлена на основе требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 января 2016 г. №7 и в соответствии с рабочим учебным планом направления 38.03.02, утвержденным Ученым советом КНИТУ-КАИ «01» июля 2019г., протокол №6		
5	П.1.4	01.07.2019	Таблицы 1а и 1б читать в редакции Приложения 1		
6	П.2.1	01.07.2019	Таблицы 3а и 3б читать в редакции Приложения 2		

Приложение 1

Таблица 1а – Объем дисциплины (модуля) для очной формы обучения

Семестр	Общая трудоемкость дисциплины (модуля), в ЗЕ/час	Виды учебной работы											
		<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий (аудиторная работа), в т.ч.:</i>							<i>Самостоятельная работа обучающегося (внеаудиторная работа), в т.ч.:</i>				
		Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Курсовая работа (консультация, защита)	Курсовой проект (консультация, защита)	Консультации перед экзаменом	Контактная работа на промежуточной аттестации	Курсовая работа (подготовка)	Курсовой проект (подготовка)	Проработка учебного материала (самоподготовка)	Подготовка к промежуточной аттестации	Форма промежуточной аттестации
8	5 ЗЕ/180	16	-	16	-	-	2	0,3	-	-	112	33,7	Экзамен
Итого	5 ЗЕ/180	16	-	16	-	-	2	0,3	-	-	112	33,7	

Таблица 1б – Объем дисциплины (модуля) для заочной формы обучения

Семестр	Общая трудоемкость дисциплины (модуля), в ЗЕ/час	Виды учебной работы											
		<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий (аудиторная работа), в т.ч.:</i>							<i>Самостоятельная работа обучающегося (внеаудиторная работа), в т.ч.:</i>				
		Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Курсовая работа (консультация, защита)	Курсовой проект (консультация, защита)	Консультации перед экзаменом	Контактная работа на промежуточной аттестации	Курсовая работа (подготовка)	Курсовой проект (подготовка)	Проработка учебного материала (самоподготовка)	Подготовка к промежуточной аттестации	Форма промежуточной аттестации
9	5 ЗЕ/180	8	-	12	-	-	2	0,3	-	-	151	6,7	Экзамен
Итого	5 ЗЕ/180	8	-	12	-	-	2	0,3	-	-	151	6,7	

Приложение 2

Таблица 3а

Распределение фонда времени по видам занятий (очная форма обучения)

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах/интерактивные часы)				Коды составляющих компетенций	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам. раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	26	4		4	18	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков							ФОС ТК-2
Тема 2.1. Методы оценки рисков	22	2		2	18	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 2.2. Методы анализа рисков	22	2		2	18	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками							ФОС ТК-3
Тема 3.1. Методы управления операционными рисками	26	4		4	18	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.2. Методы управления стратегическими рисками	22	2		2	18	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.3. Система управления рисками	26	2		2	22	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Подготовка к промежуточной аттестации	33,7				33,7	ПК-7, ПК-8	ФОС ПА 1
Контактная работа на промежуточной аттестации (экзамен)	2,3					ПК-7, ПК-8	ФОС ПА 1
ИТОГО:	180	16		16	145,7		

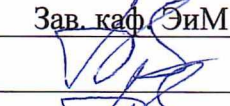
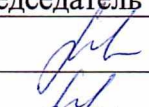
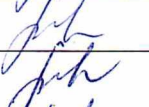
Таблица 36

Распределение фонда времени по видам занятий (заочная форма обучения)

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах/интерактивные часы)				Коды составляющих компетенций	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам. раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	29	2		2	25	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 2. Методы оценки и анализа рисков							ФОС ТК-2
Тема 2.1. Методы оценки рисков	27	1		1	25	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 2.2. Методы анализа рисков	27	1		1	25	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Раздел 3. Методические и практические инструменты управления рисками							ФОС ТК-3
Тема 3.1. Методы управления операционными рисками	29	2		2	25	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.2. Методы управления стратегическими рисками	27	1		1	25	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Тема 3.3. Система управления рисками	28	1		1	26	ПК-7, ПК-8	Текущий контроль
Подготовка к промежуточной аттестации	6,7				6,7	ПК-7, ПК-8	ФОС ПА 1
Контактная работа на промежуточной аттестации (экзамен)	2,3					ПК-7, ПК-8	ФОС ПА 1
ИТОГО:	180	8		12	157,7		

5.2 Лист утверждения рабочей программы дисциплины (модуля) на учебный год

Рабочая программа дисциплины (модуля) утверждена на ведение учебного процесса в учебном году:

Учебный год	«Согласовано» Зав. каф. ЭиМ	«Согласовано» председатель УМК филиала
2017/2018		
2018/2019		
2019/2020		
2020/2021		

2021 / 2022
2022 / 2023

